

常规报告系列

收盘日评
银行间外汇期权市场



【2023-7-25】

今天人民币兑美元中间价报 7.1406，较上一交易日调升 45 个基点。

期权 ATM 方面，1w 成交 5.9、6.0 和 6.2，1m 成交 5.35，1y 成交 4.825 和 4.85

RR 方面（25d），1m 成交 0.2，2m 成交 0.25，3m 成交 0.25

FLY 方面（25d），2w 成交 0.22

Vanilla 方面，今天短期成交比较多，on 7.2 usd call 成交 10pips，on 7.21 usd call 成交 10 和 8pips，1m 7.25 usd call 成交 80pips

CFETS-NEX FX OPTION RECAP			
7/25/2023		7.1406	-45
ATM		Traded	Changes
1w	5.0 / 7.0	5.9, 6.0, 6.2	
2w	5.0 / 6.5		
1s	4.8 / 5.8	5.35	
2s	4.5 / 5.5		
3s	4.5 / 5.5		
6s	4.3 / 5.0		
9s	4.3 / 5.0		
1y	4.3 / 5.0	4.825, 4.85	
2y	4.5 / 6.5		
3y	4.5 / 6.5		
25d RR		Traded	changes
1s	0 / 0.4	0.2	
2s	0.1 / 0.4	0.25	
3s	0.2 / 0.4	0.25	
6s	0.2 / 0.5		
9s	0.2 / 0.5		
1y	0.2 / 0.5		
25d FLY		Traded	changes
1w	0.15 / 0.3		
1s	0.15 / 0.3		
2s	0.15 / 0.3		
3s	0.15 / 0.3		
6s	0.15 / 0.3		
9s	0.15 / 0.3		
1y	0.15 / 0.3		

文 / Ben Qian

联系人：Rafael Wang
邮箱：rafael.wang@cfets-nex.com.cn

扫描二维码 轻松接收文字版收盘日评及更多资讯



免责声明：

以上所含及附加的所有信息（以下简称“信息”）仅用以提供信息，且为保密的和/或者专用的信息。其知识产权属于上海国际货币经纪有限责任公司（以下简称“上海国际货币”）或第三方，“信息”不能也不应被解释为与任何金融工具、投资或任何交易策略相关的报价、出价、建议或请求。“信息”不可作为决策依据，也不保证其完整性、时效性或准确性等要求，且可未经通知而进行修改。所有陈述和保证均经明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN